

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成27年7月13日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	D I A M高金利通貨ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	1,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

#### 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成27年1月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成26年10月31日現在）

委託会社の沿革

(略)

大株主の状況

（平成26年10月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年4月30日現在）

委託会社の沿革

(略)

大株主の状況

（平成27年4月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

#### 2【投資方針】

##### (2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

ファンド名	D I A Mマルチカレンシーファンド ( J P Y ) クラス F
(略)	

投資態度	(略) 平成26年9月末時点の投資対象国通貨は下記の通りです。当ファンドが今後も下記の通貨に投資するとは限りません。 (略)
(略)	

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

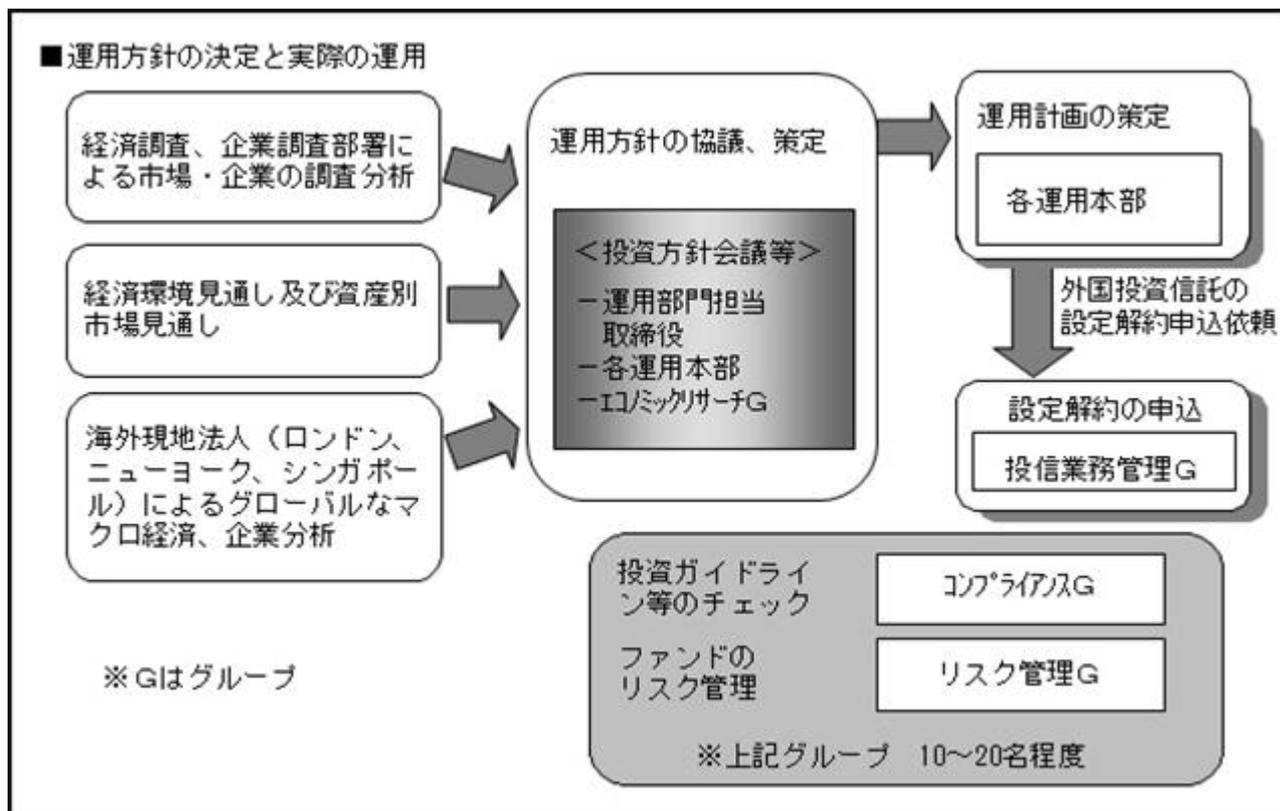
ファンド名	D I A Mマルチカレンシーファンド ( J P Y ) クラス F
(略)	
投資態度	(略) 平成27年4月末時点の投資対象国通貨は下記の通りです。当ファンドが今後も下記の通貨に投資するとは限りません。 (略)
(略)	

(略)

## ( 3 ) 【運用体制】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (3)運用体制」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

&lt;更新・訂正後&gt;



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等から得られた情報も参考にされます。

外国投資信託の設定解約の申込については、投信業務管理グループで行われます。なお、国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<運用評価・運用リスク管理体制>

<訂正前>

(略)

上記体制は平成26年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

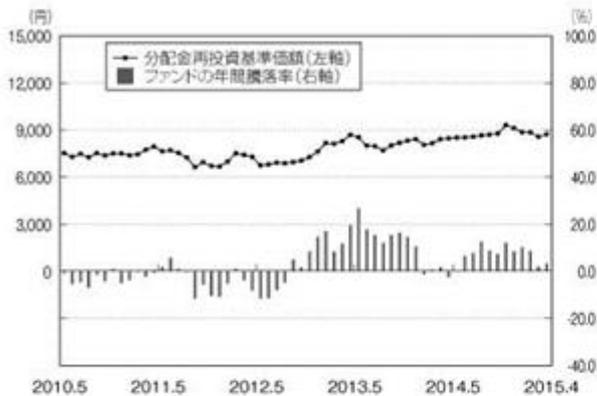
上記体制は平成27年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## （参考情報）

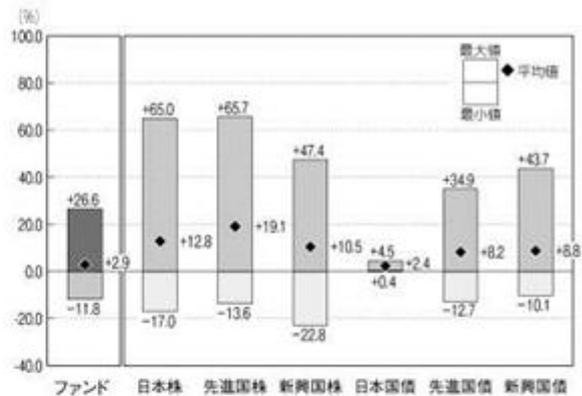
### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



2010年5月～2015年4月

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

#### \*各資産クラスの指数

- 日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (円ベース、配当込み)
- 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円ベース、配当込み)
- 日本国債…NOMURA-BPI国債
- 先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数 (TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

##### <更新・訂正後>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 換金（解約）時および償還時

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### 損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加される予定です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円（平成28年1月1日以降、年間120万円）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成27年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

##### < 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

##### < 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成27年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	876,432,548	97.25
内 ルクセンブルグ	876,432,548	97.25
親投資信託受益証券	11,830,499	1.31
内 日本	11,830,499	1.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,975,621	1.44
純資産総額	901,238,668	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	351,155,085,300	81.40
内 日本	351,155,085,300	81.40
地方債証券	28,300,959,870	6.56
内 日本	28,300,959,870	6.56
特殊債券	27,000,407,924	6.26
内 日本	27,000,407,924	6.26
社債券	23,158,765,460	5.37
内 日本	22,850,771,460	5.30
内 アメリカ	307,994,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,802,234,487	0.42
純資産総額	431,417,453,041	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	D I A Mマルチカレンシー ファンド( J P Y )クラスF ルクセンブルグ	投資信託受益 証券	197,084	4,422.00 871,505,448	4,447.00 876,432,548	- -	97.25%
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	9,608,918	1.2290 11,810,321	1.2312 11,830,499	- -	1.31%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年4月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	97.25%
親投資信託受益証券	1.31%
合計	98.56%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	3 3 4 回 利付国庫債券( 1 0 年 ) 日本	国債証券	5,000,000,000	101.75 5,087,635,000	102.89 5,144,550,000	0.600000 2024/6/20	1.19%
2	1 1 4 回 利付国庫債券( 5 年 ) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.80 5,040,300,000	100.97 5,048,850,000	0.300000 2018/9/20	1.17%
3	1 1 8 回 利付国庫債券( 5 年 ) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.34 5,017,200,000	100.65 5,032,900,000	0.200000 2019/6/20	1.17%
4	1 2 2 回 利付国庫債券( 5 年 ) 日本	国債証券	5,000,000,000	99.98 4,999,120,000	100.13 5,006,900,000	0.100000 2019/12/20	1.16%
5	3 1 3 回 利付国庫債券( 1 0 年 ) 日本	国債証券	4,300,000,000	107.03 4,602,305,000	107.03 4,602,376,000	1.300000 2021/3/20	1.07%
6	3 3 5 回 利付国庫債券( 1 0 年 ) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.73 4,533,095,000	101.91 4,586,220,000	0.500000 2024/9/20	1.06%

7	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.42 4,518,900,000	100.66 4,530,105,000	0.200000 2018/12/20	1.05%
8	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.38 4,517,310,000	100.65 4,529,520,000	0.200000 2019/3/20	1.05%
9	103回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,523,850,000	100.57 4,526,055,000	0.300000 2017/3/20	1.05%
10	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.37 4,516,830,000	100.47 4,521,330,000	0.200000 2017/9/20	1.05%
11	105回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,515,210,000	100.42 4,519,080,000	0.200000 2017/6/20	1.05%
12	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,028,000	100.51 4,321,973,000	0.200000 2017/12/20	1.00%
13	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.94 4,157,600,000	104.70 4,188,040,000	0.800000 2022/9/20	0.97%
14	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.96 4,078,680,000	103.04 4,121,600,000	0.600000 2023/12/20	0.96%
15	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	105.57 3,694,982,000	105.69 3,699,150,000	1.300000 2019/12/20	0.86%
16	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	105.97 3,603,082,000	106.00 3,604,204,000	1.500000 2019/6/20	0.84%
17	113回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,775,000	100.90 3,531,640,000	0.300000 2018/6/20	0.82%
18	102回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.48 3,517,010,000	100.50 3,517,570,000	0.300000 2016/12/20	0.82%
19	282回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	102.64 3,489,998,000	102.34 3,479,798,000	1.700000 2016/9/20	0.81%
20	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	104.98 3,464,571,000	105.01 3,465,429,000	1.400000 2018/12/20	0.80%
21	330回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.89 3,324,627,000	104.72 3,351,200,000	0.800000 2023/9/20	0.78%
22	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	104.09 3,330,912,000	103.93 3,325,824,000	1.500000 2017/12/20	0.77%
23	306回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	106.38 3,191,550,000	106.45 3,193,590,000	1.400000 2020/3/20	0.74%

24	3 2 1 回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.40 3,162,060,000	106.06 3,182,010,000	1.000000 2022/3/20	0.74%
25	2 9 6 回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.05 3,151,770,000	105.02 3,150,690,000	1.500000 2018/9/20	0.73%
26	3 2 6 回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	103.14 3,094,230,000	103.94 3,118,440,000	0.700000 2022/12/20	0.72%
27	3 2 8 回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	102.28 3,068,580,000	103.13 3,094,140,000	0.600000 2023/3/20	0.72%
28	3 3 3 回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.84 3,055,260,000	102.94 3,088,410,000	0.600000 2024/3/20	0.72%
29	1 2 0 回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.31 3,009,570,000	100.61 3,018,300,000	0.200000 2019/9/20	0.70%
30	9 9 回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.58 3,017,580,000	100.56 3,016,860,000	0.400000 2016/9/20	0.70%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年4月30日現在

種類	投資比率
国債証券	81.40%
地方債証券	6.56%
特殊債券	6.26%
社債券	5.37%
合計	99.58%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成27年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成20年4月11日)	2,272	2,289	0.8908	0.8973
第2特定期間末 (平成20年10月14日)	7,314	7,391	0.6719	0.6789
第3特定期間末 (平成21年4月13日)	10,112	10,221	0.6509	0.6579
第4特定期間末 (平成21年10月13日)	9,607	9,682	0.6435	0.6485
第5特定期間末 (平成22年4月12日)	7,776	7,836	0.6506	0.6556
第6特定期間末 (平成22年10月12日)	5,408	5,456	0.5713	0.5763
第7特定期間末 (平成23年4月11日)	4,501	4,539	0.5893	0.5943
第8特定期間末 (平成23年10月11日)	2,692	2,721	0.4531	0.4581
第9特定期間末 (平成24年4月11日)	2,324	2,349	0.4665	0.4715
第10特定期間末 (平成24年10月11日)	1,908	1,926	0.4171	0.4211
第11特定期間末 (平成25年4月11日)	1,598	1,607	0.5137	0.5167
第12特定期間末 (平成25年10月11日)	1,273	1,282	0.4505	0.4535
第13特定期間末 (平成26年4月11日)	1,114	1,121	0.4564	0.4594
第14特定期間末 (平成26年10月14日)	993	999	0.4435	0.4465
第15特定期間末 (平成27年4月13日)	906	912	0.4297	0.4327
平成26年4月末日	1,084	-	0.4538	-
5月末日	1,072	-	0.4533	-
6月末日	1,048	-	0.4507	-
7月末日	1,046	-	0.4507	-
8月末日	1,029	-	0.4515	-
9月末日	1,012	-	0.4514	-
10月末日	1,003	-	0.4519	-
11月末日	1,036	-	0.4763	-
12月末日	992	-	0.4636	-
平成27年1月末日	958	-	0.4472	-
2月末日	947	-	0.4439	-

3月末日	905	-	0.4270	-
4月末日	901	-	0.4319	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0065
第2特定期間	0.0400
第3特定期間	0.0420
第4特定期間	0.0340
第5特定期間	0.0300
第6特定期間	0.0300
第7特定期間	0.0300
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0250
第11特定期間	0.0190
第12特定期間	0.0180
第13特定期間	0.0180
第14特定期間	0.0180
第15特定期間	0.0180

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	10.3
第2特定期間	20.1
第3特定期間	3.1
第4特定期間	4.1
第5特定期間	5.8
第6特定期間	7.6
第7特定期間	8.4
第8特定期間	18.0
第9特定期間	9.6
第10特定期間	5.2
第11特定期間	27.7
第12特定期間	8.8
第13特定期間	5.3
第14特定期間	1.1
第15特定期間	0.9

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配額の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配額の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1特定期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	2,629,095,816	77,789,024
第2特定期間	8,761,546,516	425,819,093
第3特定期間	5,135,772,292	487,302,676
第4特定期間	2,011,880,844	2,615,718,875
第5特定期間	488,429,094	3,466,642,018
第6特定期間	260,391,356	2,745,913,430
第7特定期間	175,633,748	2,004,268,227
第8特定期間	205,094,655	1,902,609,557
第9特定期間	138,510,945	1,096,271,038
第10特定期間	163,594,414	572,568,481
第11特定期間	116,557,648	1,579,935,616
第12特定期間	84,670,838	368,107,788
第13特定期間	68,672,226	456,022,333
第14特定期間	61,234,079	262,586,711
第15特定期間	83,807,714	214,168,692

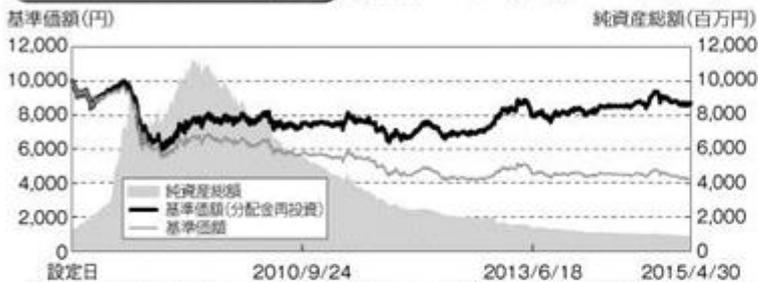
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2015年4月30日

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2007年12月27日)～2015年4月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。

(設定日：2007年12月27日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	投資比率
1	DIAMマルチカレンシーファンド(JPY)クラスF	投資信託受益証券	ルクセンブルグ	97.25%
2	国内債券バッシュ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1.31%

■DIAMマルチカレンシーファンド(JPY)の内容 ※DIAM International Ltdの現地月末データを基に作成しています。

## 組入銘柄一覧

順位	銘柄名	通貨	クーポン(%)	償還日	投資比率(%)
1	地方公共団体金融機構	日本円	2.000%	2016/5/9	11.71%
2	オンタリオ州債	日本円	0.930%	2015/6/8	11.42%
3	豪州国債	オーストラリアドル	4.750%	2015/10/21	10.89%
4	ナティクス銀行	オーストラリアドル	2.410%	2015/5/10	10.73%
5	フランス相互信用連合銀	オーストラリアドル	2.330%	2015/6/2	10.71%
6	フランス開発庁	日本円	1.800%	2015/6/19	10.42%

※投資比率はDIAMマルチカレンシーファンド(JPY)の純資産総額に対する割合です。

## 投資対象通貨別配分

ルーマニア・レイ	1.9%
英ポンド	1.5%
トルコ・リラ	11.7%
南アフリカ・ランド	12.3%
ブラジル・レアル	12.7%
メキシコ・ペソ	12.0%
インド・ルピー	12.9%
オーストラリア・ドル	32.7%
日本円	2.4%

※比率はDIAMマルチカレンシーファンド(JPY)の純資産総額に対する割合です。

※通貨別配分は為替予約取引等を含めた実質的な比率です。

■国内債券バッシュ・ファンド・マザーファンド (注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書きは、当該資産の発行体の国または地域別です。

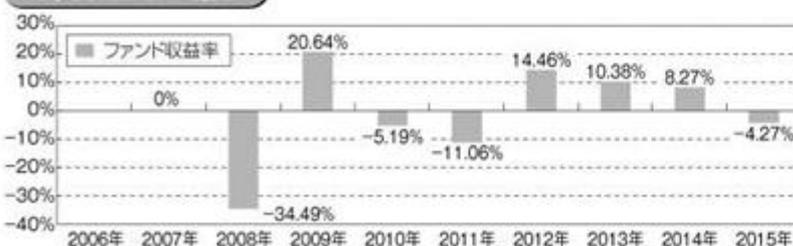
## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	81.40
内 日本	81.40
地方債証券	6.56
内 日本	6.56
特殊債券	6.26
内 日本	6.26
社債券	5.37
内 日本	5.30
内 アメリカ	0.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.42
純資産総額	100.00

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	334回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/6/20	1.19%
2	114回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2018/9/20	1.17%
3	118回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.17%
4	122回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.16%
5	313回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	1.300000	2021/3/20	1.07%
6	335回 利付国債債券(10年)	国債証券	日本	0.500000	2024/9/20	1.06%
7	116回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.05%
8	117回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.05%
9	103回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.300000	2017/3/20	1.05%
10	106回 利付国債債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.05%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2007年は設定日から年末までの収益率、および2015年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成26年10月15日から平成27年4月13日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## D I A M高金利通貨ファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成26年10月14日現在	当 期 平成27年4月13日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	21,538,853	21,658,084
投資信託受益証券	968,009,511	882,118,248
親投資信託受益証券	11,614,299	11,810,321
流動資産合計	1,001,162,663	915,586,653
資産合計	1,001,162,663	915,586,653
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,718,588	6,327,505
未払解約金	498,999	2,290,923
未払受託者報酬	39,857	35,595
未払委託者報酬	757,430	676,487
その他未払費用	4,720	4,211
流動負債合計	8,019,594	9,334,721
負債合計	8,019,594	9,334,721
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,239,529,604	1,210,168,626
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 1,246,386,535	2 1,202,916,694
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	993,143,069	906,251,932
純資産合計	993,143,069	906,251,932
負債純資産合計	1,001,162,663	915,586,653

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 平成26年4月12日 至 平成26年10月14日	当 期 自 平成26年10月15日 至 平成27年4月13日
営業収益		
受取配当金	39,936,780	36,503,280
受取利息	4,911	5,555
有価証券売買等損益	23,321,328	21,385,141
営業収益合計	16,620,363	15,123,694
営業費用		
受託者報酬	231,987	208,140
委託者報酬	4,408,641	3,955,717
その他費用	27,469	24,631
営業費用合計	4,668,097	4,188,488
営業利益又は営業損失（ ）	11,952,266	10,935,206
経常利益又は経常損失（ ）	11,952,266	10,935,206
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,952,266	10,935,206
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	616,457	1,158,608
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,326,781,597	1,246,386,535
剰余金増加額又は欠損金減少額	144,324,396	117,769,740
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	144,324,396	117,769,740
剰余金減少額又は欠損金増加額	33,632,970	45,512,068
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,632,970	45,512,068
分配金	1 41,632,173	1 38,564,429
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,246,386,535	1,202,916,694

## ( 3 ) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日の取扱い</p> <p>当ファンドは、原則として毎年4月11日及び10月11日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を平成26年10月14日、当特定期間末日を平成27年4月13日としております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成26年10月14日現在	当 期 平成27年4月13日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2,440,882,236円 61,234,079円 262,586,711円	2,239,529,604円 83,807,714円 214,168,692円
2. 受益権の総数	2,239,529,604口	2,109,168,626口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,246,386,535円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,202,916,694円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 平成26年 4月12日 至 平成26年10月14日	当 期 自 平成26年10月15日 至 平成27年 4月13日

<p>1 . 1 分配金の計算過程</p>	<p>（自平成26年4月12日 至平成26年5月12日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,050,836円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（56,276,066円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は62,326,902円（1万口当たり261.64円）であり、うち7,146,555円（1万口当たり30円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。）</p> <p>（自平成26年5月13日 至平成26年6月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,032,260円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（54,561,861円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は60,594,121円（1万口当たり257.25円）であり、うち7,066,324円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成26年6月12日 至平成26年7月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,923,924円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（52,731,733円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は58,655,657円（1万口当たり252.79円）であり、うち6,960,976円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成26年10月15日 至平成26年11月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,142,097円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（46,020,235円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は52,162,332円（1万口当たり239.69円）であり、うち6,528,653円（1万口当たり30円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。）</p> <p>（自平成26年11月12日 至平成26年12月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,902,361円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（45,370,725円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は51,273,086円（1万口当たり237.16円）であり、うち6,485,896円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成26年12月12日 至平成27年1月13日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,118,133円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（44,334,859円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は49,452,992円（1万口当たり231.08円）であり、うち6,420,233円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
-----------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>（自平成26年7月12日 至平成26年8月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,879,038円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（51,613,984円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は57,493,022円（1万口当たり248.17円）であり、うち6,949,943円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成27年1月14日 至平成27年2月12日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,366,312円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（42,957,829円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は48,324,141円（1万口当たり226.22円）であり、うち6,408,588円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成26年8月12日 至平成26年9月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,402,890円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（49,380,804円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は55,783,694円（1万口当たり246.47円）であり、うち6,789,787円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成27年2月13日 至平成27年3月11日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,455,612円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（41,820,289円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は47,275,901円（1万口当たり221.83円）であり、うち6,393,554円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成26年9月12日 至平成26年10月14日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,594,631円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（48,481,703円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は54,076,334円（1万口当たり241.46円）であり、うち6,718,588円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成27年3月12日 至平成27年4月13日）          計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,346,919円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（40,467,142円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は45,814,061円（1万口当たり217.21円）であり、うち6,327,505円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 平成26年 4月12日 至 平成26年10月14日	当 期 自 平成26年10月15日 至 平成27年 4月13日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成26年10月14日現在	当 期 平成27年4月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 平成26年10月14日現在	当 期 平成27年4月13日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	22,596,126	797,936
親投資信託受益証券	60,536	79,754
合計	22,535,590	877,690

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前 期 平成26年10月14日現在	当 期 平成27年4月13日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4435円 (4,435円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成27年4月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	D I A Mマルチカレンシーファンド( J P Y )クラスF	199,484	882,118,248	
投資信託受益証券	合計	199,484	882,118,248	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,608,918	11,810,321	
親投資信託受益証券	合計	9,608,918	11,810,321	
合計		9,808,402	893,928,569	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスF」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」及び「投資信託受益証券」は、すべてこれらの受益証券であります。

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成26年10月14日現在	平成27年4月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,072,521,557	3,151,451,857
国債証券		352,269,817,500	348,605,298,900
地方債証券		28,129,856,544	27,931,772,026
特殊債券		28,378,072,220	26,847,820,605
社債券		24,398,242,540	23,672,126,260
未収入金		-	2,124,570,000
未収利息		938,997,994	867,999,791
前払費用		27,607,874	18,642,816
流動資産合計		437,215,116,229	433,219,682,255
資産合計		437,215,116,229	433,219,682,255
負債の部			
流動負債			
未払金		-	1,381,073,080
未払解約金		230,251,000	290,832,000
流動負債合計		230,251,000	1,671,905,080
負債合計		230,251,000	1,671,905,080
純資産の部			
元本等			
元本	1	361,526,979,605	351,120,330,661
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		75,457,885,624	80,427,446,514
元本等合計		436,984,865,229	431,547,777,175
純資産合計		436,984,865,229	431,547,777,175
負債純資産合計		437,215,116,229	433,219,682,255

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年10月14日現在	平成27年4月13日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	368,751,082,193円	361,526,979,605円
同期中追加設定元本額	16,037,397,949円	36,360,907,049円
同期中一部解約元本額	23,261,500,537円	46,767,555,993円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	8,134,358,606円	9,645,634,389円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	10,523,309,285円	10,870,098,702円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	4,113,154,206円	4,404,224,245円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	6,408,903,562円	6,815,228,476円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,641,438,111円	2,856,630,373円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,631,426,034円	1,675,287,547円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,765,107,039円	1,837,488,279円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	252,472,850円	256,932,141円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	153,659,881円	139,964,830円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,035,817,392円	2,325,155,207円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	5,188,641円	5,770,946円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	129,138,169円	165,746,592円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	90,402,582円	124,610,427円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	26,056,680円	38,306,870円
投資のソムリエ	1,778,225,764円	5,749,686,003円
クルーズコントロール	1,135,428,735円	1,911,715,086円
投資のソムリエ< D C年金>	39,364,371円	85,859,735円

D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	179,287,874円	398,819,232円
D I A M DC バランス・F (成長型)	93,111円	10,565,893円
クルーズコントロール<DC年 金>	43,672円	457,432円
みずほエマージングボンドオー プン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	12,460,868,785円	12,305,879,146円
D I A Mアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	239,084,565円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	707,867,730円	713,320,583円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	5,536,767,785円	3,582,541,548円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	450,826,903円	394,061,208円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	319,026,321円	238,697,075円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	781,924,762円	656,311,026円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	305,097,031円	228,482,535円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	272,732,303円	236,189,996円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	30,729,364,696円	23,093,567,225円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	10,080,949,404円	8,347,691,769円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	13,282,788,132円	12,238,911,030円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	5,014,024,494円	4,830,446,182円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	8,206,931,489円	8,264,677,670円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	1,133,414,767円	1,003,403,745円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機 関投資家限定)	5,217,291,677円	4,480,597,125円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	6,293,000,980円	6,015,493,392円
D I A M世界アセットバラン スファンドV A (適格機関投資家 向け)	9,976,927,459円	8,709,092,304円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	492,774,489円	495,049,617円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	11,526,343,408円	8,773,360,226円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	8,330,542,690円	8,433,706,171円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	1,199,607,208円	686,276,383円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	105,295,049,849円	105,238,300,655円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,795,242,947円	1,615,752,425円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	9,149,245,173円	9,158,612,659円
D I A M世界アセットバラン スファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	32,909,221,724円	33,182,504,720円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	492,262円	503,645円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	150,957,319円	376,687円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	84,760,411円	103,886,601円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	36,826,487,740円	37,044,764,182円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	687,764,705円	672,622,857円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	173,523,177円	174,887,472円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	570,211,592円	580,331円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	491,894,879円	607,205,864円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	317,910円	5,448,798円
計	361,526,979,605円	351,120,330,661円
2 . 受益権の総数	361,526,979,605口	351,120,330,661口

--	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年 4月12日 至 平成26年10月14日	自 平成26年10月15日 至 平成27年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年10月14日現在	平成27年4月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年10月14日現在	平成27年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,711,185,200	3,581,961,700
地方債証券	28,636,924	75,931,974
特殊債証券	53,460,239	38,248,892
社債証券	42,241,020	2,111,320
合計	1,644,120,865	3,694,031,246

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成26年2月15日から平成26年10月14日まで及び平成27年2月17日から平成27年4月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年10月14日現在	平成27年4月13日現在
1口当たり純資産額	1.2087円	1.2291円
（1万口当たり純資産額）	（12,087円）	（12,291円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成27年4月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	340回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,160,000	
	341回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,320,000	
	342回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,480,000	
	343回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,501,995,000	
	344回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,820,000	
	345回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,000,000	
	348回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,504,375,000	
	349回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,502,745,000	
	350回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,620,000	
	97回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,160,000	
	99回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,190,000	
	101回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,013,440,000	
	102回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,517,640,000	
	103回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,525,560,000	
	105回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,519,620,000	
	106回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,521,330,000	
	107回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,321,887,000	
	109回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,004,960,000	
	110回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,680,000	
	112回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,518,105,000	
	113回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,150,000	
	114回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,541,625,000	
	116回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,526,460,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,526,460,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,029,150,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,560,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,501,650,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,003,450,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	500,000,000	500,245,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	719,514,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,200,330,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,201,280,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	1,259,126,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,004,013,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	844,512,000	
	280回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,533,645,000	
	282回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,482,790,000	
	284回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,337,167,000	
	285回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,549,170,000	
	286回 利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,702,050,000	

288回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,561,845,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,327,840,000	
290回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,040,540,000	
293回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,852,766,000	
296回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,150,690,000	
297回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,465,000,000	
299回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,727,946,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,604,918,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,435,171,000	
305回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,699,150,000	
306回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,193,620,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,381,107,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,104,160,000	
310回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,936,948,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,868,615,000	
313回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,605,472,000	
315回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,882,439,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,595,355,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,797,206,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,131,340,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,588,545,000	
321回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,181,410,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,616,350,000	
325回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,186,480,000	
326回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,117,000,000	
328回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,093,630,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,884,654,000	
330回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,350,880,000	
332回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,118,960,000	
333回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,087,630,000	
334回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,143,200,000	
335回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,584,645,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,017,380,000	
337回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,495,300,000	
338回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,006,240,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	128,964,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,535,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,190,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,066,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	241,302,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,254,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	366,024,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	568,820,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	446,508,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	354,393,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	348,870,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	614,345,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,284,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	498,028,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,440,000	

18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	990,551,800	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	241,428,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	372,555,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	603,125,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	584,426,200	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	745,578,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	372,843,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	722,880,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,224,260,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,120,653,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	997,768,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,598,467,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,574,625,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,429,416,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,700,398,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,723,740,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,789,545,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,725,225,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,952,926,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,803,232,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,102,440,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	900,856,000	
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,102,650,000	
41回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,185,723,000	
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,076,170,000	
43回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,075,520,000	
44回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,612,275,000	
45回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,332,838,000	
46回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	307,623,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	645,168,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	430,332,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	776,044,800	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	880,160,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	967,766,600	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,002,501,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	554,600,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,058,708,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	568,150,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	863,327,400	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	670,470,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	620,334,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	797,307,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	914,992,200	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,271,385,600	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	676,434,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,081,109,700	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	850,280,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,361,139,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	682,884,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,255,826,000	

67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,172,840,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,489,187,500	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,460,412,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,381,637,600	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,642,172,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,673,401,500	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,632,498,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,648,878,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,005,762,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,805,970,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,672,762,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,778,640,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	822,829,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	949,968,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,819,395,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,922,880,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,667,134,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,047,225,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,091,646,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,147,634,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,028,831,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,217,490,000	
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,415,040,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,269,493,000	
114回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,388,680,000	
116回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,656,808,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,415,040,000	
119回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,381,128,000	
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,445,870,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,267,859,000	
125回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,414,340,000	
128回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,161,750,000	
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,146,540,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,175,937,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,143,789,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,028,052,000	
135回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,351,944,000	
137回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,474,758,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,132,256,000	
141回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,464,704,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,645,040,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,120,913,000	
146回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,228,300,000	
147回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,407,768,000	
148回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,150,600,000	
149回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,681,750,000	
150回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,316,776,000	
151回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,536,325,000	
152回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	506,100,000	
国債証券 合計		323,320,000,000	348,605,298,900	

地方債証券	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	205,272,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	154,362,000	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	102,958,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	213,491,850	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	314,394,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	317,280,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	212,242,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	525,335,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	208,512,000	
	6 9 7 回 東京都公募公債	500,000,000	529,245,000	
	7 0 1 回 東京都公募公債	700,000,000	737,205,000	
	7 0 8 回 東京都公募公債	500,000,000	524,440,000	
	7 2 0 回 東京都公募公債	300,000,000	314,415,000	
	7 2 6 回 東京都公募公債	400,000,000	414,384,000	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	194,839,590	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	102,734,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	312,306,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	212,376,000	
	2 2 年度 1 2 回 北海道公募公債	200,000,000	212,426,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	316,356,000	
	1 9 4 回 神奈川県公募公債	300,000,000	312,489,000	
	2 0 8 回 神奈川県公募公債	300,000,000	305,637,000	
	2 9 3 回 大阪府公募公債	200,000,000	205,528,000	
	3 0 1 回 大阪府公募公債	100,000,000	103,525,000	
	3 0 7 回 大阪府公募公債	100,000,000	104,421,000	
	3 1 0 回 大阪府公募公債	240,000,000	250,149,600	
	3 1 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	211,058,000	
	3 3 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	212,640,000	
	3 4 5 回 大阪府公募公債	300,000,000	318,192,000	
	3 5 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	211,446,000	
	3 6 4 回 大阪府公募公債	300,000,000	311,631,000	
	3 7 4 回 大阪府公募公債	300,000,000	315,231,000	
	8 3 回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	301,308,000	
	1 8 年度 1 回 京都府公募公債	100,000,000	102,765,000	
	2 6 年度 1 1 回 京都府公募公債	350,000,000	353,136,000	
	1 9 年度 2 回 兵庫県公募公債	200,000,000	207,210,000	
	1 8 年度 5 回 静岡県公募公債	129,800,000	133,366,904	
	2 1 年度 5 回 静岡県公募公債	197,000,000	207,789,690	
	2 2 年度 8 回 静岡県公募公債	200,000,000	209,678,000	
	2 3 年度 9 回 静岡県公募公債	200,000,000	211,590,000	
	1 8 年度 2 回 愛知県公募公債	160,300,000	164,044,608	
	2 0 年度 4 回 愛知県公募公債	100,000,000	105,214,000	
	2 2 年度 6 回 愛知県公募公債	200,000,000	210,800,000	
	2 3 年度 2 0 回 愛知県公募公債	500,000,000	530,995,000	
	2 5 年度 4 回 愛知県公募公債	300,000,000	313,983,000	
	2 2 年度 1 回 広島県公募公債	200,000,000	212,396,000	
2 1 年度 4 回 埼玉県公募公債	440,000,000	465,282,400		
2 3 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	212,544,000		
2 6 年度 5 回 埼玉県公募公債	400,000,000	409,580,000		
1 8 年度 1 回 福岡県公募公債	104,000,000	106,926,560		

21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	212,442,000		
25年度11回	福岡県公募公債	200,000,000	206,454,000		
19年度5回	千葉県公募公債	300,000,000	313,548,000		
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	211,380,000		
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	311,340,000		
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	209,162,000		
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	173,938,180		
40回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,919,500		
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	166,832,608		
54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	416,060,000		
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,032,000		
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,518,000		
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,389,000		
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,166,000		
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	531,980,000		
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	745,143,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	531,265,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	743,645,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,161,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	530,025,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	734,265,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,225,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,990,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	828,331,443		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,035,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,072,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,020,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,480,000		
18年度2回	大阪市公募公債	100,000,000	102,273,000		
18年度3回	大阪市公募公債	150,000,000	153,877,500		
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	140,788,800		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	459,985,500		
18年度3回	京都市公募公債	101,700,000	105,187,293		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	210,914,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	212,460,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	475,785,000		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	419,620,000		
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	312,339,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	208,406,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	107,679,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	211,338,000		
18年度4回	福岡市公募公債	100,000,000	102,668,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	214,502,000		
地方債証券 合計		26,726,300,000	27,931,772,026		
特殊債券	13回	政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	124,231,910	
	27回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	205,384,000	
	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,210,000	
	15回	高速道路機構債	400,000,000	411,144,000	
	25回	高速道路機構債	300,000,000	312,510,000	
	35回	高速道路機構債	400,000,000	417,952,000	

4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	742,847,000	
9 6 回 高速道路機構債	700,000,000	726,054,000	
1 1 6 回 高速道路機構債	100,000,000	103,053,000	
9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,421,000	
1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	308,588,210	
1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	125,297,660	
1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	339,186,000	
1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,558,000	
2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	385,706,250	
2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,454,000	
3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	309,702,000	
3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	306,982,170	
3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	357,935,440	
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	345,610,340	
4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,810,000	
5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	519,755,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,076,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	746,415,250	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	169,967,160	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	422,658,010	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	629,130,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	736,967,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,888,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,798,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,038,210,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,465,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	525,220,000	

195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	347,457,000	
867回 政保公営企業債券	200,000,000	205,040,000	
868回 政保公営企業債券	101,000,000	103,697,710	
869回 政保公営企業債券	102,000,000	104,876,400	
875回 政保公営企業債券	482,000,000	498,735,040	
881回 政保公営企業債券	500,000,000	520,130,000	
8回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	688,458,540	
3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,091,310	
5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	527,490,000	
8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,722,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	528,695,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,166,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,300,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,105,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,165,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	526,300,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,724,000	
20回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	204,608,000	
24回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	309,273,000	
19回 都市再生機構債券	200,000,000	211,258,000	
11回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,306,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	316,260,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	73,296,000	79,546,682	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,042,000	55,239,694	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	75,636,000	81,962,195	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	82,365,000	89,693,837	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,642,000	39,882,451	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	192,350,000	202,067,522	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,718,000	49,794,687	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,050,000	36,132,904	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	123,188,000	134,756,585	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	98,490,000	107,341,296	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,110,000	182,430,794	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,420,000	293,904,626	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	529,928,000	566,413,542	
736号 利付商工債	300,000,000	301,374,000	
740号 利付商工債	300,000,000	301,689,000	
737号 利附農林債	300,000,000	301,542,000	
743号 利附農林債	300,000,000	301,734,000	
753号 利附農林債	300,000,000	300,642,000	
760号 利附農林債	300,000,000	302,007,000	
764号 利附農林債	500,000,000	502,545,000	
261回 利附信金中金債	300,000,000	301,332,000	
275回 利附信金中金債	400,000,000	401,720,000	
282回 利附信金中金債	300,000,000	301,395,000	
171号 利附商工債（3年）	200,000,000	200,264,000	

	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	174,411,500	
	10回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	221,013,550	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	315,243,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	211,770,000	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	267,088,570	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	120,838,770	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	521,000,000	
特殊債券 合計		25,776,235,000	26,847,820,605	
社債券	9回 JPモルガン・チェース円貨債	200,000,000	203,944,000	
	12回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	104,239,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	313,056,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	106,220,000	
	3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	105,654,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	105,804,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	106,076,000	
	12回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,596,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,430,000	
	29回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,019,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	105,901,000	
	1回 日本電産社債	100,000,000	100,547,000	
	11回 パナソニック社債	100,000,000	102,594,000	
	19回 三菱重工業社債	100,000,000	102,681,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	101,162,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	209,950,000	
	16回 トヨタ自動車社債	100,000,000	102,244,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	106,546,000	
	58回 伊藤忠商事社債	100,000,000	100,524,000	
	66回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,918,000	
	91回 丸紅社債	100,000,000	100,689,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	101,520,000	
	69回 三菱商事社債	300,000,000	316,857,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,764,000	
	7回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	313,017,000	
	27回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,545,000	
	29回 みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	502,870,000	
	31回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,089,000	
	32回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,434,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	108,727,000	
	126回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,536,000	
	134回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,659,000	
	140回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,789,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	216,582,000	
	11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,382,000	
	12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	208,898,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,514,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,692,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	322,869,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,875,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,975,000	

7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	212,504,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,807,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	103,475,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,285,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,016,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	103,381,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,886,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,972,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,952,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,188,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	216,090,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,464,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	427,836,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,047,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,791,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	215,426,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,631,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,735,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,589,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,354,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	216,612,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	308,121,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	103,464,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	203,964,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,450,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,590,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,964,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,858,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	304,800,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	199,410,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,355,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	212,462,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	206,458,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	104,550,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	212,220,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,504,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	102,506,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	105,457,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	102,815,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,540,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	338,574,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,340,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,347,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	316,947,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	211,270,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	341,988,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,317,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	114,528,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	196,076,200	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	215,702,000	

23回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,055,000	
3回 東京地下鉄社債	100,000,000	102,578,000	
5回 KDDI社債	100,000,000	106,217,000	
51回 日本電信電話社債	200,000,000	204,632,000	
54回 日本電信電話社債	200,000,000	209,848,000	
60回 日本電信電話社債	300,000,000	318,258,000	
15回 NTTドコモ社債	200,000,000	211,368,000	
455回 東京電力社債	200,000,000	204,714,000	
542回 東京電力社債	500,000,000	504,185,000	
409回 中部電力社債	300,000,000	313,407,000	
476回 中部電力社債	100,000,000	105,969,000	
478回 中部電力社債	100,000,000	102,496,000	
480回 中部電力社債	200,000,000	205,824,000	
496回 中部電力社債	500,000,000	523,000,000	
410回 関西電力社債	300,000,000	316,809,000	
486回 関西電力社債	154,000,000	155,754,060	
492回 関西電力社債	200,000,000	201,268,000	
493回 関西電力社債	200,000,000	201,040,000	
310回 中国電力社債	200,000,000	213,826,000	
377回 中国電力社債	200,000,000	209,644,000	
260回 北陸電力社債	100,000,000	110,004,000	
281回 北陸電力社債	200,000,000	210,258,000	
380回 東北電力社債	300,000,000	316,245,000	
473回 東北電力社債	300,000,000	303,486,000	
237回 四国電力社債	100,000,000	106,386,000	
253回 四国電力社債	200,000,000	207,626,000	
423回 九州電力社債	200,000,000	204,894,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	208,072,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	410,100,000	
17回 電源開発社債	100,000,000	102,231,000	
17回 東京ガス社債	100,000,000	107,821,000	
9回 大阪ガス社債	100,000,000	107,727,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	108,877,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	104,501,000	
社債券 合計	22,744,000,000	23,672,126,260	
合計	398,566,535,000	427,057,017,791	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスF」は、「D I A M高金利通貨ファンド」が投資対象とする外国投資信託受益証券です。

D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスFはルクセンブルグ籍外国投資信託受益証券です。

2013年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下の「純資産計算書」、「財務諸表に対する注記」及び「組み入れ投資有価証券明細」は、2013年12月31日現在の財務諸表の原文の一部を抜粋・翻訳したものです。

### 純資産計算書

2013年12月31日現在

（日本円で表示）

	注記	D I A Mマルチカレンシーファンド ( J P Y )	日本円
<b>資産</b>			
投資有価証券、時価	2.3		684,117,234
投資有価証券、原価			682,330,923
銀行預金			452,635,219
為替先渡契約に係る未実現利益	2.7,11		8,469,693
未収債券利息			192,877
<b>資産合計</b>			<b>1,145,415,023</b>
<b>負債</b>			
未払償還金			2,826,000
未払投資運用報酬および運用会社報酬			1,699,156
未払管理手数料			569,980
未払専門家報酬			1,650,325
未払保管費用			194,551
未払取引手数料			15,000
未払年次税（“Taxe d'abonnement”）			28,453
その他の未払金			329,021
<b>負債合計</b>			<b>7,312,486</b>
<b>純資産</b>			<b>1,138,102,537</b>
発行済ユニット数			
クラスF			240,871
1ユニット当たり純資産価値			
クラスF	日本円		4,725

**財務諸表に対する注記**

2013年12月31日現在

\*訳者注 財務諸表に対する注記は原文の一部を抜粋・翻訳したものです。

**注記2 - 重要な会計方針****2.1 財務諸表の表示**

当財務諸表は、共同投資のための事業体に関するルクセンブルグの規制に準拠して表示されている。

**2.2 勘定**

財務諸表は日本円で表示されている。日本円以外で作成された財務諸表は期末の為替レートで換算されている。

**2.3 投資有価証券**

証券取引所に上場している有価証券またはその他の規制市場で取引されている有価証券は、かかる証券取引所または市場での直近の終値で評価されている。有価証券が複数の証券取引所または市場に上場している場合は、かかる有価証券の主要な市場を構成する証券取引所または市場での直近の終値で決定される。

証券取引所に上場していない有価証券またはその他の規制市場で取引されていない有価証券は、直近の入手可能な市場価格で評価される。

上述の価格が公正な市場価値を表さない有価証券は、合理的に予想可能な売却価格に基づき、慎重かつ誠実に評価される。

残存期間が12か月未満の短期金融市場有価証券の価値は、その市場価値であるものとみなされる。ただし、かかる市場価値が入手不可能であるか、または市場価値を表しておらず、当該有価証券が市場価値に近似する償却原価法で評価されている場合を除く。

ポートフォリオがその総資産のほとんどすべてを投資することを容認されている共同投資ファンドの株式またはユニットを含む、オープンエンド型投資ファンドの株式またはユニットは、直近で入手可能な算出された純資産価値で評価される。

**2.4 投資有価証券売却に係る実現利益 / (損失)**

投資有価証券売却に係る実現利益 / (損失) は、売却した投資有価証券の平均取得原価に基づき決定される。

**2.5 外貨換算**

ポートフォリオの通貨以外の通貨建ての資産および負債は、期末の為替レートでポートフォリオの通貨に換算される。

ポートフォリオの通貨以外の通貨建ての利益および費用は、取引日の為替レートでポートフォリオの通貨に換算される。

日本円以外の通貨建ての有価証券の取得原価は、購入日の為替レートで換算される。

為替取引による損益は、当期の成績を決定する損益計算書および純資産変動計算書に計上される。

2013年12月31日現在の為替レートは以下の通りである。

オーストラリア・ドル/日本円	=	94.0322	ルーマニア・レイ/日本円	=	32.4438
ブラジル・レアル/日本円	=	44.5502	シンガポール・ドル/日本円	=	83.2449
ユーロ/日本円	=	144.8294	トルコ・リラ/日本円	=	48.9202
イギリス・ポンド/日本円	=	174.0802	アメリカ・ドル/日本円	=	105.1050
ハンガリー・フォリント/日本円	=	0.4875	南アフリカ・ランド/日本円	=	10.0351
インド・ルピー/日本円	=	1.6992			

オーストラリア・ドル/アメリカ・ドル	=	0.8947	日本円/アメリカ・ドル	=	0.0095
ブラジル・レアル/アメリカ・ドル	=	0.4239	韓国・ウォン/アメリカ・ドル	=	0.0009
カナダ・ドル/アメリカ・ドル	=	0.9412	メキシコ・ペソ/アメリカ・ドル	=	0.0764
スイス・フラン/アメリカ・ドル	=	1.1244	マレーシア・リングgit/アメリカ・ドル	=	0.3053
チェコ・コルナ/アメリカ・ドル	=	0.0503	フィリピン・ペソ/アメリカ・ドル	=	0.0225
デンマーク・クローネ/アメリカ・ドル	=	0.1847	ポーランド・ズロチ/アメリカ・ドル	=	0.3314
ユーロ/アメリカ・ドル	=	1.3780	スウェーデン・クローナ/アメリカ・ドル	=	0.1557
イギリス・ポンド/アメリカ・ドル	=	1.6563	シンガポール・ドル/アメリカ・ドル	=	0.7920
香港・ドル/アメリカ・ドル	=	0.1290	タイ・バーツ/アメリカ・ドル	=	0.0304
インドネシア・ルピア/アメリカ・ドル	=	0.0001	台湾・ドル/アメリカ・ドル	=	0.0336
インド・ルピー/アメリカ・ドル	=	0.0162	南アフリカ・ランド/アメリカ・ドル	=	0.0955

## 2.6 設定費

設定費は5年間で償却される。

## 2.7 為替先渡契約

為替先渡契約は、満期までの残存期間に応じて、期末現在で適用される先物レートで評価される。

為替先渡契約から生じる損益は、損益計算書および純資産変動計算書に計上される。

## 2.9 収入の認識

分配金は分配原資から源泉徴収税を控除した純額で表示され、分配落ち日に収入として計上される。受取利息は発生主義に基づいて計上されている。

### 注記11 - 為替先渡契約

2013年12月31日現在、D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）において、為替先渡契約に係る未実現利益は8,469,693円である。

2013年12月31日現在、ゴールドマン・サックス・ロンドンとの為替先渡契約の残高は以下の通りである。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現利益/(損失) (日本円)
ルーマニア・レイ	4,300,000	日本円	136,138,000	2014/1/9	3,325,846
南アフリカ・ランド	13,250,000	日本円	131,440,000	2014/1/9	1,347,475
イギリス・ポンド	810,000	日本円	136,729,620	2014/1/9	4,264,713
日本円	6,372,800	ルーマニア・レイ	200,000	2014/1/9	(113,840)

2013年12月31日現在、J P モルガンとの為替先渡契約の残高は以下の通りである。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現利益/(損失) (日本円)
トルコ・リラ	2,400,000	日本円	120,960,000	2014/1/9	(3,767,783)

2013年12月31日現在、ロイヤル・バンク・オブ・スコットランド・ロンドンとの為替先渡契約の残高は以下の通りである。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現利益/(損失) (日本円)
オーストラリア・ドル	450,000	日本円	42,048,180	2014/1/9	241,340
ハンガリー・フォント	100,000,000	日本円	46,820,000	2014/1/9	1,908,682
ブラジル・リアル	2,837,000	日本円	125,168,440	2014/1/9	993,829
日本円	8,417,285	イギリス・ポンド	50,000	2014/1/9	(286,049)
日本円	8,403,650	イギリス・ポンド	50,000	2014/1/9	(299,684)
日本円	17,367,175	南アフリカ・ランド	1,750,000	2014/1/9	(170,554)
日本円	8,509,050	イギリス・ポンド	50,000	2014/1/9	(194,284)

## 組み入れ投資有価証券明細

2013年12月31日現在

(日本円で表示)

額面	銘柄	通貨	取得原価	評価額	純資産価値に 対する比率
			日本円	日本円	%
<b>公認の証券取引所に上場されている、もしくはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券</b>					
<b>債券</b>					
<b>日本</b>					
400,000,000	DEVELOPMENT BANK OF JAPAN 1.600% 20/06/14	日本円	404,057,000	402,640,000	35.38
	日本小計		404,057,000	402,640,000	35.38
	債券合計		404,057,000	402,640,000	35.38
<b>ゼロクーポン債</b>					
<b>オーストラリア</b>					
1,000,000	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 0.000% 21/02/14	オーストラ リア・ドル	92,571,515	93,696,496	8.23
	オーストラリア小計		92,571,515	93,696,496	8.23
	ゼロクーポン債		92,571,515	93,696,496	8.23
<b>コマーシャルペーパー</b>					
<b>ドイツ</b>					
1,000,000	DEUTSCHE ZENTRAL GENOSSENSCHAFT BANK AG ECP (AUD) 08/01/14	オーストラ リア・ドル	92,559,477	93,978,188	8.26
	ドイツ小計		92,559,477	93,978,188	8.26
<b>イギリス</b>					
1,000,000	SUMITOMO CORP CAPITAL EUR PLC CP (AUD) 03/02/14	オーストラ リア・ドル	93,142,931	93,802,550	8.24
	イギリス小計		93,142,931	93,802,550	8.24
	コマーシャルペーパー合計		185,702,408	187,780,738	16.50
	<b>投資有価証券合計</b>		<b>682,330,923</b>	<b>684,117,234</b>	<b>60.11</b>

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成27年4月30日現在

資産総額	906,274,740円
負債総額	5,036,072円
純資産総額（ - ）	901,238,668円
発行済数量	2,086,817,763口
1口当たり純資産額（ / ）	0.4319円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年4月30日現在

資産総額	437,060,355,841円
負債総額	5,642,902,800円
純資産総額（ - ）	431,417,453,041円
発行済数量	350,412,746,797口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2312円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

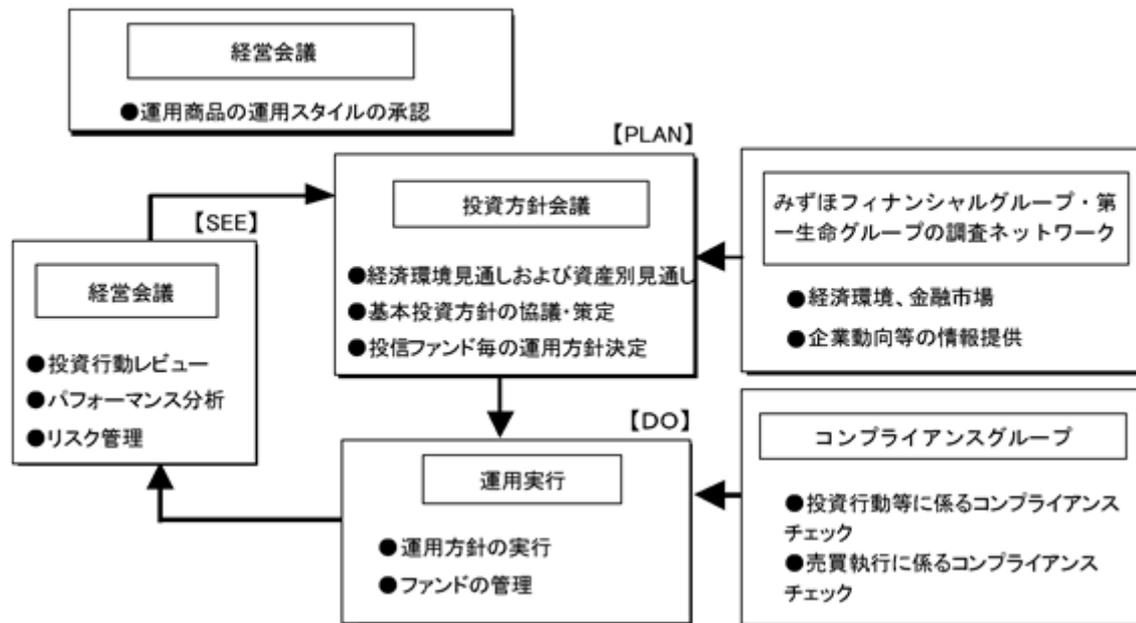
投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成27年4月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成27年4月30日現在、委託会社の運用する投資信託は363本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	6	15,478,378,634
追加型株式投資信託	331	5,827,361,965,909
単位型公社債投資信託	26	218,881,239,201
追加型公社債投資信託	0	0
合計	363	6,061,721,583,744

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	617,159	613,137
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	第29期 ( 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 )		第30期 ( 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日 )	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
会計方針の 変更による 累積的影響 額									
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の 変更による 累積的影響 額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の 積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変 更による累積 的影響額		131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

## 重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

## 2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

		第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

## （損益計算書関係）

## 1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

## 2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

## （2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等でありませ

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替及び市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

#### 第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

#### 第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

当事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第29期（平成26年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

## 第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額  
該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券  
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券  
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券  
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,952,459	1,628,835

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	14,169,657	2,544,066

2. 満期保有目的の金銭の信託  
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託  
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引  
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引  
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(非積立型制度であります)を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり  
ます。

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資 産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## （3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社の関係会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有)直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社の関係会社	東京都千代田区	3,431 億円	生命保険業	(被所有)直接 50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	627,855	未払 費用	224,758
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	251,110	未払 費用	97,587

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又 は出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	658,756	未払 費用	235,583
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	383,980	未払 費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	増資の引受	400,000	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その 他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 行)	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	2,646	
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
関係 会社 の子 会社	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	407,531	未払 費用	240,725
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	6,501
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46銭

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（注3）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1名称、資本金の額及び事業の内容」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)受託会社

## a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

平成27年3月末日現在 247,369百万円

## c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託銀行業務を営んでいます。

## (2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	日本において銀行業務を営んでおります。
ソニー銀行株式会社	31,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東洋証券株式会社	13,494	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ばんせい証券株式会社	1,558	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
フィデリティ証券株式会社	5,957	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
リテラ・クレア証券株式会社	3,794	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
----------	--------	----------------------------------

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月3日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M高金利通貨ファンドの平成26年10月15日から平成27年4月13日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M高金利通貨ファンドの平成27年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

D I A Mアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。